

II

(Незаконодателни актове)

РЕГЛАМЕНТИ

ДЕЛЕГИРАН РЕГЛАМЕНТ (ЕС) 2018/1229 НА КОМИСИЯТА

от 25 май 2018 година

за допълване на Регламент (ЕС) № 909/2014 на Европейския парламент и на Съвета по отношение на регулаторните технически стандарти за дисциплина при сетълмента

(текст от значение за ЕИП)

ЕВРОПЕЙСКАТА КОМИСИЯ,

като взе предвид Договора за функционирането на Европейския съюз,

като взе предвид Регламент (ЕС) № 909/2014 на Европейския парламент и на Съвета от 23 юли 2014 г. за подобряване на сетълмента на ценни книжа в Европейския съюз и за централните депозитари на ценни книжа, както и за изменение на директиви 98/26/ЕО и 2014/65/ЕС и Регламент (ЕС) № 236/2012⁽¹⁾, и по-специално член 6, параграф 5 и член 7, параграф 15 от него,

като има предвид, че:

- (1) Разпоредбите в настоящия регламент са тясно свързани помежду си, тъй като се отнасят до мерките за предотвратяване и справяне с неуспешен сетълмент и за насърчаване на дисциплината при сетълмента посредством наблюдение на случаите на неуспешен сетълмент, събиране и разпределяне на парични санкции за неуспешен сетълмент и определяне на оперативните детайли на процеса на изкупуване. С цел да се осигури съгласуваност между разпоредбите и да се осигури възможност за цялостен поглед и лесен достъп до тях от страна на лицата, по отношение на които тези задължения са приложими, е целесъобразно тези разпоредби да бъдат включени в един регламент.
- (2) Като се има предвид глобалният характер на финансовите пазари, следва да се обърне сериозно внимание на принципите за инфраструктурата на финансовите пазари, издадени от Комитета по платежни и сетълмент системи и Международната организация на комисиите по ценни книжа („Принципи на КПСС—МОКЦК“) през м. април 2012 г., които служат като глобален еталон за регулаторните изисквания към централните депозитари на ценни книжа (ЦДЦК). Следва да се вземат предвид така също препоръките за системите за сетълмент на ценни книжа, издадени от Комитета по платежни и сетълмент системи и Международната организация на комисиите по ценни книжа, в които се разглеждат въпроси за потвърждаването на спелки, циклите на сетълмента и предоставянето в заем на ценни книжа.
- (3) Редица термини следва да бъдат дефинирани, за да се гарантира последователното прилагане на Регламент (ЕС) № 909/2014 и да се определят техническите термини, които са необходими за прилагането на настоящия регламент.
- (4) Инвестиционните посредници следва да гарантират, че своевременно разполагат с цялата необходима информация за сетълмента, която им е необходима за извършването на ефективен и ефикасен сетълмент на сделките. По-специално инвестиционните посредници, които не разполагат с необходимата информация за сетълмента, следва да се свържат с клиентите си, за да получат информацията, която е от значение за ефикасния сетълмент, в това число стандартизираните данни, необходими за процеса на сетълмент.
- (5) Следва да се насърчава изцяло автоматизираната обработка (АО), тъй като използването на АО на целия пазар е от съществена важност както за поддържането на високи норми на сетълмент с нарастването на обемите, така и за гарантирането на навременен сетълмент при трансгранични сделки. Освен това както преките, така и непреките

⁽¹⁾ OBL 257, 28.8.2014 г., стр. 1.

участници на пазара следва да въведат вътрешна автоматизация, която е необходима, за да се възползват в пълна степен от наличните решения за АО. В това отношение инвестиционните посредници следва да предоставят възможност на професионалните си клиенти да изпращат потвърждения и данни за разпределения по електронен път, и по-специално чрез международни процедури и стандарти за открита комуникация за изпращане на съобщения и референтни данни. Освен това ЦДЦК следва да улесняват АО, а при обработването на инструкции за сетълмент следва да използват процеси, които са проектирани за работа на автоматична база по подразбиране.

- (6) ЦДЦК следва да предлагат възможности за съгласуване през целия ден, за да се насърчава ранния сетълмент на предвидената дата за сетълмент.
- (7) ЦДЦК следва да изискват от участниците в своите системи за сетълмент на ценни книжа да използват списък със задължителни полета за съгласуване за целите на съгласуването на инструкции за сетълмент, за да се улесни сетълмента и да се гарантира последователност във всички системи за сетълмент на ценни книжа.
- (8) ЦДЦК следва да разполагат със системи с надеждни и ефикасни функционални възможности, както и с политики и процедури, които им позволяват да улесняват и осигуряват стимули за сетълмента на предвидената дата за сетълмент.
- (9) ЦДЦК следва да предоставят на участниците достъп в реално време до информация за статуса на техните инструкции за сетълмент в управляваните от тях системи за сетълмент на ценни книжа, за да насърчават и осигуряват стимули за навременния сетълмент от тези участници.
- (10) ЦДЦК следва да предлагат брутен сетълмент в реално време за участниците в своите системи за сетълмент на ценни книжа или най-малкото възможности за сетълмент няколко пъти през всеки работен ден, за да приключат окончателния сетълмент в рамките на деня.
- (11) Задължението системата на ЦДЦК да разполага със функционални възможности следва да бъде обвързано с ефикасността на сетълмента на тези ЦДЦК. По тази причина някои функционални възможности на системата не следва да бъдат задължителни, ако стойността и процентът на случаите на неуспешен сетълмент в управляваната от ЦДЦК система за сетълмент на ценни книжа не надвишават дадени предварително определени прагове.
- (12) За да се улесни наблюдението на случаи на неуспешен сетълмент, следва ЦДЦК да използват хармонизирана методика за докладване на случаи на неуспешен сетълмент пред компетентните органи и съответните органи. Тази методика следва да включва общ списък с елементи, които подлежат на отчитане, както и честотата на представяне на докладите. Инструкциите за сетълмент, които са въведени в управляваната от ЦДЦК система за сетълмент на ценни книжа, следва да се наблюдават всеки ден, докато сетълментът бъде извършен или отменен.
- (13) ЦДЦК следва да сключват работни договорености с участниците, които имат най-висок процент на неуспешен сетълмент, както и, ако е приложимо, със съответните централни контрагенти (ЦК) и места за търговия, за да се установяват основните причини за неуспешен сетълмент.
- (14) ЦДЦК следва да изпращат месечни доклади относно случаите на неуспешен сетълмент до своите компетентни органи и до съответните органи. Компетентните органи следва да имат право също така да изискват допълнителна информация за случаите на неуспешен сетълмент или по-често докладване, ако е необходимо, така че да могат да изпълняват своите задачи. Изискващите компетентни органи следва да споделят тази допълнителна информация или доклади със съответните органи без неоправдано забавяне.
- (15) ЦДЦК следва да използват единен образец за публично оповестяване на данни за неуспешен сетълмент, за да се насърчава прозрачността и да се осигури съпоставимост на случаите на неуспешен сетълмент в рамките на Съюза.
- (16) За да се гарантира последователното прилагане на изискванията към ЦДЦК за дисциплина при сетълмента, следва да бъдат определени подробни разпоредби за идентифицирането на всички сделки, които остават неуредени след предвидената дата за сетълмент, за прилагането на процеса на изкупуване, ако е приложимо, както и за прилагането на механизмите за санкции, установени от съответния ЦДЦК, в това число момента на изчисляване и събиране и разпределяне на паричните санкции.
- (17) Правилата относно процесите за събиране и разпределяне на паричните санкции за случаи на неуспешен сетълмент следва да се прилагат в съответствие с Делегиран регламент (ЕС) 2017/389 на Комисията ⁽¹⁾.

⁽¹⁾ Делегиран регламент (ЕС) 2017/389 на Комисията от 11 ноември 2016 г. за допълване на Регламент (ЕС) № 909/2014 на Европейския парламент и на Съвета по отношение на параметрите за изчисляване на паричните санкции за неуспешен сетълмент и на операциите на ЦДЦК в приемащите държави членки (ОВ L 65, 10.3.2017 г., стр. 1).

- (18) За да се гарантира последователното прилагане на паричните санкции за неуспешен сетълмент, ЦДЦК следва редовно, но най-малко веднъж месечно да начисляват, събират и разпределят парични санкции. Освен това, за да се гарантира, че рисковият профил на ЦДЦК не е засегнат от функционирането на механизма за санкции, включително когато санкциите не са платени от неизправните участници съгласно изискванията, ЦДЦК следва да носи отговорност единствено за начисляването, събирането и разпределянето на тези парични санкции. Тъй като даден участник може да действа и като агент на свои собствени клиенти, ЦДЦК следва да предоставят на участниците достатъчно детайли за изчисляването на санкциите, за да могат те да събират паричните санкции от техните клиенти.
- (19) Важно е паричната санкция, която се налага в случай на неуспешен сетълмент, да не представлява източник на доходи за ЦДЦК. Поради това паричната санкция следва да се плаща по отделна сметка на ЦДЦК, която да се използва единствено за събирането и разпределянето на тези санкции. Събраните санкции не следва да се използват за финансиране на внедряването, поддържането или функционирането на механизма за санкции.
- (20) В определени случаи дадена сделка може да е част от верига от сделки, като в този случай инструкцията за сетълмент може да зависи от друга, а сетълментът по една инструкция може да позволява извършването на сетълмент по различни инструкции във въпросната верига. Поради това изпълнението на една инструкция за сетълмент може да има верижен ефект, който да доведе до неизпълнение на следващите инструкции за сетълмент.
- (21) По тази причина, за да се ограничи броят на прехвърляния на парични средства, ЦДЦК следва да приспадат дължимата на участниците сума от сумата, която подлежи на плащане от тези участници, както и да гарантират правилното разпределяне на цялата сума на паричните санкции в рамките на веригата на сетълмента между онези участници, които са претърпели загуби от неуспешния сетълмент. ЦДЦК следва да предоставят на участниците достатъчно информация относно изчисляването на сумите за получаване, за да могат въпросните участници, когато е приложимо, да прехвърлят дължимите суми към своите клиенти.
- (22) Механизмът за санкции следва да се прилага за всички неуспешни сделки, включително за подлежащите на клиринг сделки. Когато обаче неизправният участник е ЦК, санкцията не следва да се дължи от въпросния ЦК, а от съответния клирингов член, който е причинил неуспешния сетълмент. Поради тази причина ЦДЦК следва да предоставят на ЦК цялата необходима информация относно неуспешния сетълмент и изчисляването на санкцията, за да може ЦК да начисли санкцията на съответния клирингов член и да разпреди събраната сума на клиринговия член, който е претърпял загуби от последващ неуспешен сетълмент по същите финансови инструменти.
- (23) ЦДЦК, които използват обща инфраструктура за сетълмент, следва да работят в тясно сътрудничество, за да се гарантира подходящото прилагане на механизма за санкции.
- (24) Процесът на изкупуване следва да се хармонизира, за да се подпомогне интегрирания пазар за сетълмент на ценни книжа. Като се има предвид колко важно е да се осигурят стимули за предприемането на навременни действия за справяне със случаите на неуспешен сетълмент, важно е всички съответни участващи страни да бъдат постоянно осведомени по време на процеса на изкупуване.
- (25) Дадена инструкция за сетълмент може да е неуспешна по отношение на всички финансови инструменти, които са включени във въпросната инструкция, дори в сметката на неизправния участник някои финансови инструменти да са налични за доставка. Целта на процеса на изкупуване е да се подобри ефикасността на сетълмента. За да се сведе до минимум броят на изкупуванията, в процеса на изкупуване следва задължително да се прилага частичен сетълмент по отношение на съответната инструкция за сетълмент.
- (26) Със задължителния частичен сетълмент в последния работен ден от удължения срок, предвиден в член 7, параграф 3 от Регламент (ЕС) № 909/2014, се осигурява точният баланс между правата на купувача да получи закупените финансови инструменти и необходимостта да се сведе до минимум броят на финансовите инструменти, които са обект на изкупуване. Следователно всеки изкупен финансов инструмент следва да бъде доставен на купувача, дори броят на закупените финансови инструменти да не позволява пълния сетълмент на съответната инструкция за сетълмент.
- (27) Задължителен частичен сетълмент не следва да се прилага за инструкции за сетълмент, които са били задържани от участник, тъй като съответните финансови инструменти по свързаната сметка може да не принадлежат на клиента, за който е била вписана инструкцията за сетълмент в системата за сетълмент на ценни книжа.
- (28) За да се гарантира спазването на задълженията, които са определени в Регламент (ЕС) № 909/2014, всички страни във веригата за сетълмент следва да имат договорни споразумения със съответните си контрагенти, в които да са предвидени задълженията в процеса на изкупуване и да са изпълними във всички съответни юрисдикции.

- (29) За да се подобри ефикасността на сетълмента, винаги първо следва да се проверява дали е възможен процес на изкупуване по отношение на съответните сделки и страните по тях.
- (30) Всички субекти, които участват в процеса на изкупуване, следва да бъдат информирани на ключови етапи за статуса на процеса на изкупуване. Тази информация следва да се обменя под формата на съобщения, за да може участващите субекти да са запознати със статуса на действията за сетълмент на сделката и да предприемат по-нататъшни действия, ако е необходимо.
- (31) За сделки, които не подлежат на клиринг от ЦК, за да се въведе ефикасен процес на изкупуване и да се избегне други страни или участници във веригата за сетълмент да поемат отговорност за задължения, за които е сключен договор от членовете на място за търговия или от търгуващите страни, както и с цел да не се повиши рисковият профил на ЦДЦК или на местата за търговия, отговорност за изкупуването следва да носят страните, които първоначално са сключили съответната сделка.
- (32) Що се отнася до сетълмента на сделка с ценни книжа, участниците действат от свое собствено име или вписват инструкции за сетълмент в управляваната от ЦДЦК система за сетълмент на ценни книжа по искане на своите клиенти. Тези клиенти могат да бъдат ЦК и неговите клирингови членове, членове на място за търговия или, когато сделката не се осъществява на място за търговия, търгуващи страни. Поради това изкупуването следва да се извършва на нивото, на което са били създадени договорните задължения за купуване или продажба на ценни книжа.
- (33) Като се има предвид, че агентът по изкупуването следва да действа по искане на страна, която не поема разходите, свързани с неговата интервенция по изкупуването, тогава агентът по изкупуването следва да действа в съответствие с изискванията за най-добро изпълнение и да защитава интереса на неизправния клирингов член, на члена на място за търговия или на търгуващата страна.
- (34) За да се ограничи броят на изкупуванията и да се запази ликвидността на пазара на съответните финансови инструменти, неизправният клирингов член, неизправният член на място за търговия или неизправната търгуваща страна, според случая, следва да има право чрез своите участници да доставя финансови инструменти на ЦК, на получаващите членове на място за търговия или на получаващите търгуващи страни до момента, когато те бъдат уведомени, че е назначен агент по изкупуването или че е обявен търг. Считано от този момент във времето, въпросните страни следва да могат единствено да участват в търга за финансовите инструменти или да ги доставят на агента по изкупуването, което подлежи на предварително одобрение от него, за да се предотврати възможността получаващият клирингов член, получаващият член на място за търговия или получаващата търгуваща страна да получи финансовите инструменти два пъти. Страните, които участват в процеса на изкупуване, биха могли също така да ограничат броя на изкупуванията, като координират действията помежду си и уведомят ЦДЦК за това, когато сделката е част от верига от сделки и може да доведе до различни инструкции за сетълмент.
- (35) Сделките, които не подлежат на клиринг от ЦК, обикновено са необезпечени и съответно всеки член на място за търговия или търгуваща страна е изложен/а на риск от контрагента. Ако този риск се прехвърли към други субекти като техни участници например, последните ще бъдат принудени да покрият своята експозиция на риск от контрагента. Това би могло да доведе до непропорционално по-високи разходи за сетълмента на ценни книжа. Поради това неизправният клирингов член, неизправният член на място за търговия или неизправната търгуваща страна, според случая, най-напред следва да поеме отговорност за плащане на разходите по изкупуването, разликата в цената и паричното обезщетение. Когато неизправният член на място за търговия или неизправната търгуваща страна не изпълнява задължението си да плаща тези суми, техният участник, в качеството си на неизправен участник, следва все пак да покрие разходите по изкупуването и разликата в цената, но не и паричното обезщетение.
- (36) Задълженията за доставката на изкупени финансови инструменти или за плащането на парично обезщетение или на някаква разлика в цената на финансовите инструменти, които са обект на изкупуване, в крайна сметка следва да се изпълняват чрез приемането на съответните финансови инструменти или парични средства от ЦК, получаващите членове на място за търговия или получаващите търгуващи страни посредством техните участници.
- (37) Когато изкупуването е неуспешно и в рамките на предвидения срок липсва изрично съобщение дали да се удължи периодът на изкупуване, тогава следва да бъде заплатено парично обезщетение, за да се защитят интересите на страните и да се избегне каквато и да било несигурност вследствие на неуспешното изкупуване.
- (38) За да се избегнат усложнения и да се защити ЦК, получаващият член на място за търговия или получаващата търгуваща страна, изкупените финансови инструменти следва да се доставят на ЦК, на получаващия член на място за търговия или на получаващата търгуваща страна чрез съответния получаващ участник, а не чрез неизправния участник. Поради същите причини първоначалната инструкция за сетълмент, с която е задействан процесът на изкупуване, следва да бъде задържана и впоследствие отменена.

- (39) С оглед на правилното изчисляване и прилагане на санкциите за неуспешен сетълмент след края на удължения срок, съответните инструкции за сетълмент следва да бъдат отменени и заменени с нови инструкции за сетълмент във всеки работен ден, в който ЦК, членовете на място за търговия или търгуващите страни получават финансови инструменти чрез своите участници в резултат на изкупуване. Парични санкции следва да се прилагат за всяка нова инструкция за сетълмент, считано от деня, в който е вписана в системата за сетълмент на ценни книжа.
- (40) За да се гарантира безпроблемното функциониране на управляваните от ЦДЦК системи за сетълмент на ценни книжа, както и сигурността на графика за процеса на изкупуване и за плащането на парични санкции за неуспешен сетълмент, неизпълнените инструкции за сетълмент следва да бъдат отменени при доставката на финансови инструменти, или, ако последните не бъдат доставени, при плащането на паричното обезщетение или най-късно на втория работен ден след уведомяването за размера на дължимото парично обезщетение.
- (41) Когато цената на финансовите инструменти, която е договорена към момента на сключване на сделката, е по-ниска от цената, заплатена при изкупуването, разликата в цената следва да бъде платена от неизправния клирингов член, член на място за търговия или търгуваща страна, според случая, за да се защитят интересите на получаващите страни. Когато цената на финансовите инструменти, която е договорена към момента на сключване на сделката, е по-висока от цената, заплатена при изкупуването, задължението на неизправния участник, посочено в член 7, параграф 6 от Регламент (ЕС) № 909/2014, следва да се счита за изпълнено, като се има предвид, че в действителност получаващите клирингови членове, членове на място за търговия или търгуващи страни плащат за изкупените финансови инструменти.
- (42) За ефикасен процес на сетълмент е необходимо удълженият срок, който тече преди стартирането на процеса на изкупуване, да бъде съобразен с вида на активите и с ликвидността на финансовите инструменти. Когато пазарът на акции е достатъчно ликвиден, за да се получават лесно, удълженият срок преди стартирането на процеса на изкупуване не следва да бъде удължаван, за да имат стимул съответните страни да извършат навременно сетълмента на неуспешните сделки. За акциите, за които няма ликвиден пазар, следва обаче да се предвиди по-дълъг удължен срок. За дългови инструменти също следва да се ползва по-дълъг удължен срок, като се има предвид по-широкото им трансгранично измерение и тяхното значение за гладкото и правилно функциониране на финансовите пазари.
- (43) Мерките за справяне със случаите на неуспешен сетълмент, свързани с изкупуване и санкции, може да наложат значителни промени в информационно технологичните системи, пазарни тестове и изменения на правните договорености между съответните страни, включително ЦДЦК и други пазарни участници. Затова за прилагането на тези мерки следва да се предвиди достатъчно време, за да се гарантира, че съответните страни ще могат да изпълнят необходимите изисквания.
- (44) Настоящият регламент се основава на проектите на регулаторни технически стандарти, представени от ЕОЦКП на Европейската комисия в съответствие с процедурата по член 10 от Регламент (ЕС) № 1095/2010 на Европейския парламент и на Съвета ⁽¹⁾.
- (45) ЕОЦКП проведе открити обществени консултации по тези проекти на регулаторни технически стандарти, анализира свързаните с тях потенциални разходи и ползи и поиска становището на Групата на участниците от сектора на ценните книжа и пазарите, създадена съгласно член 37 от Регламент (ЕС) № 1095/2010. При разработването на проектите на регулаторни технически стандарти ЕОЦКП работи в тясно сътрудничество и с членовете на Европейската система на централните банки,

ПРИЕ НАСТОЯЩИЯ РЕГЛАМЕНТ:

ГЛАВА I

Общи разпоредби

Член 1

Определения

За целите на настоящия регламент се прилагат следните определения:

- а) „клирингов член“ означава предприятие съгласно определеното в член 2, точка 14 от Регламент (ЕС) № 648/2012 на Европейския парламент и на Съвета ⁽²⁾;

⁽¹⁾ Регламент (ЕС) № 1095/2010 на Европейския парламент и на Съвета от 24 ноември 2010 г. за създаване на Европейски надзорен орган (Европейски орган за ценни книжа и пазари), за изменение на Решение № 716/2009/ЕО и за отмяна на Решение 2009/77/ЕО на Комисията (ОВ L 331, 15.12.2010 г., стр. 84).

⁽²⁾ Регламент (ЕС) № 648/2012 на Европейския парламент и на Съвета от 4 юли 2012 г. относно извънборсовите деривати, централните контрагенти и регистрите на трансакции (ОВ L 201, 27.7.2012 г., стр. 1).

- б) „борсово търгуван фонд (БТФ)“ означава фонд съгласно определеното в член 4, параграф 1, точка 46 от Директива 2014/65/ЕС на Европейския парламент и на Съвета ⁽¹⁾;
- в) „изпълнение на нареждания“ означава „изпълнение на нареждания от името на клиенти“ съгласно определеното в член 4, параграф 1, точка 5 от Директива 2014/65/ЕС;
- г) „непрофесионален клиент“ означава непрофесионален клиент съгласно определеното в член 4, параграф 1, точка 11 от Директива 2014/65/ЕС;
- д) „инструкция за сетълмент“ означава нареждане за превод съгласно определеното в член 2, подточка i) от Директива 98/26/ЕО на Европейския парламент и на Съвета ⁽²⁾;
- е) „търгуваща страна“ означава страна, която действа като принципал в сделка с ценни книжа по смисъла на член 7, параграф 10, буква в), първа алинея от Регламент (ЕС) № 909/2014;
- ж) „член на място за търговия“ означава член или участник на място за търговия.

ГЛАВА II

Мерки за предотвратяване на неуспешен сетълмент

Член 2

Мерки по отношение на професионалните клиенти

1. Инвестиционните посредници изискват от своите професионални клиенти да им изпращат писмено разпределяне на ценните книжа или на паричните средства по сделките, посочени в член 5, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 909/2014, като посочват сметките, които да бъдат съответно заверени или задължени. В писмените разпределяния се указва следното:

- а) един от следните видове сделки:
 - i) покупка или продажба на ценни книжа;
 - ii) операции по управление на обезпечения;
 - iii) операции по предоставяне/вземане в заем на ценни книжа;
 - iv) репо сделки;
 - v) други сделки, които могат да бъдат идентифицирани с по-конкретни кодове по ISO;
- б) международния идентификационен номер на ценните книжа (ISIN номер) на финансовия инструмент или, ако ISIN номерът не е на разположение, някакъв друг код за идентифициране на финансовия инструмент;
- в) доставката или получаването на финансови инструменти или парични средства;
- г) номиналната стойност за дългови инструменти и количеството за други финансови инструменти;
- д) датата на сключване на сделката;
- е) цената на финансовия инструмент при сключването на сделката;
- ж) валутата, в която е обявена сделката;
- з) предвидената дата за сетълмент на сделката;
- и) общата сума на паричните средства за предоставяне или получаване;
- й) кода за идентифициране на субекта, в който се държат ценните книжа;
- к) кода за идентифициране на субекта, в който се държат паричните средства;
- л) наименованията и номерата на ценните книжа или паричните сметки, които да бъдат заверени или задължени.

Писмените разпределяния включват всяка друга информация, която се изисква от инвестиционния посредник с цел улесняване на сетълмента на сделката.

Инвестиционните посредници, които са получили потвърждение за изпълнение на нареждане за сделка, подадено от професионален клиент, гарантират чрез договорните споразумения, че професионалният клиент потвърждава в писмен вид, че приема условията на сделката в рамките на определените в параграф 2 срокове. Това писмено потвърждение може също да бъде включено в писменото разпределяне.

⁽¹⁾ Директива 2014/65/ЕС на Европейския парламент и на Съвета от 15 май 2014 г. относно пазарите на финансови инструменти и за изменение на Директива 2002/92/ЕО и на Директива 2011/61/ЕС (ОВ L 173, 12.6.2014 г., стр. 349).

⁽²⁾ Директива 98/26/ЕО на Европейския парламент и на Съвета от 19 май 1998 г. относно окончателността на сетълмента в платежните системи и в системите за сетълмент на ценни книжа (ОВ L 166, 11.6.1998 г., стр. 45).

Инвестиционните посредници предоставят на своите професионални клиенти възможност да изпращат писменото разпределяне и писменото потвърждение по електронен път, чрез международните процедури и стандарти за открита комуникация за изпращане на съобщения и референтни данни, посочени в член 35 от Регламент (ЕС) № 909/2014.

2. Професионалните клиенти гарантират, че писмените разпределяния и писмените потвърждения, посочени в параграф 1, са получени от инвестиционния посредник в рамките на един от следните крайни срокове:

- a) до прекратяване на операциите в работния ден, в който е сключена сделката, когато инвестиционният посредник и съответният професионален клиент се намират в една и съща часова зона;
- б) до 12:00 ч. централноевропейско време (СЕТ) на работния ден, следващ деня, в който е сключена сделката, при настъпване на един от следните случаи:
 - i) има разлика от повече от два часа между часовата зона на инвестиционния посредник и часовата зона на съответния професионален клиент;
 - ii) нарежданията са изпълнени след 16:00 ч. СЕТ в работния ден в рамките на часовата зона на инвестиционния посредник.

Инвестиционните посредници потвърждават получаването на писменото разпределяне и на писменото потвърждение в рамките на два часа от въпросното получаване. Когато писменото разпределяне и писменото потвърждение са получени от инвестиционен посредник в рамките на по-малко от един час преди прекратяването на неговите операции, въпросният инвестиционен посредник потвърждава получаването на писменото разпределяне и на писменото потвърждение в рамките на един час след началото на операциите на следващия работен ден.

3. Когато инвестиционните посредници получат необходимата информация за сетълмента, посочена в параграф 1, преди сроковете, указани в параграф 2, те могат да се договорят в писмен вид със своите професионални клиенти, че не е необходимо да се изпращат съответните писмени разпределяния и писмени потвърждения.

4. Параграфи 1, 2 и 3 не се прилагат за професионални клиенти, които държат при един и същ инвестиционен посредник ценните книжа и паричните средства, нужни за сетълмента.

Член 3

Мерки по отношение на непрофесионални клиенти

Инвестиционните посредници изискват от своите непрофесионални клиенти да им изпращат цялата информация, свързана със сетълмента на сделките, посочени в член 5, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 909/2014, до 12:00 ч. СЕТ в работния ден, следващ деня, в който е сключена сделката, в рамките на часовата зона на инвестиционния посредник, освен когато даден клиент държи съответните финансови инструменти и парични средства при един и същ инвестиционен посредник.

Член 4

Улесняване и обработване на сетълмент

1. ЦДЦК обработва автоматично всички инструкции за сетълмент.
2. ЦДЦК, които са извършили ръчна интервенция в автоматичния процес на сетълмент по начина, посочен в параграф 3, буква а) или буква б), уведомяват компетентния орган за причината за тази интервенция в рамките на 30 дни от настъпването на събитието, освен ако вече е изпращано уведомление за същата причина при предходни интервенции.
3. Ръчна интервенция в автоматичния процес на сетълмент се извършва при следните обстоятелства:
 - a) когато подаването на получена инструкция за сетълмент в системата за сетълмент на ценни книжа е било забавено или модифицирано или когато самата инструкция за сетълмент е била модифицирана извън автоматичните процедури;
 - б) когато при обработването на получени инструкции за сетълмент в инструмента за сетълмент бъде осъществена интервенция извън рамките на автоматичните процедури, в това число решаването на проблеми от информационни технологично естество.
4. Компетентните органи могат да уведомят ЦДЦК по всяко време, че посочената причина не оправдава ръчната интервенция в автоматизирания процес на сетълмент. Поради това ЦДЦК не извършват впоследствие ръчна интервенция в автоматизиран процес за сетълмент въз основа на тази причина.

Член 5

Съгласуване и попълване на инструкциите за сетълмент

1. ЦДЦК предоставят на участниците функционална възможност, с която се поддържа напълно автоматично и непрекъснато съгласуване на инструкции за сетълмент в реално време през целия работен ден.
2. ЦДЦК изискват от участниците да съгласуват инструкциите си за сетълмент с помощта на посочената в параграф 1 функционална възможност преди техния сетълмент, освен при следните обстоятелства:
 - а) когато ЦДЦК е приел, че инструкциите за сетълмент вече са съгласувани от местата за търговия, ЦК или други субекти;
 - б) когато самият ЦДЦК е съгласувал инструкциите за сетълмент;
 - в) в случай на инструкции за сетълмент без плащане (FoP), посочени в член 13, параграф 1, буква ж), подточка i), които съдържат нареждания за преводи на финансови инструменти между различни сметки, открити на името на същия участник или управлявани от същия оператор на сметки.

Операторите на сметки, посочени в буква в), включват субекти, които имат договорни отношения с ЦДЦК и които управляват сметки за ценни книжа, поддържани от същия ЦДЦК, чрез вписването на записи във въпросните сметки за ценни книжа.

3. ЦДЦК изискват от участниците да използват следните полета за съгласуване в техните инструкции за сетълмент с оглед на съгласуването на инструкциите за сетълмент:
 - а) вида на инструкцията за сетълмент според посоченото в член 13, параграф 1, буква ж);
 - б) предвидената дата за сетълмент на инструкцията за сетълмент;
 - в) датата на сключване на сделката;
 - г) валутата, освен в случай на инструкции за сетълмент FoP;
 - д) сумата на сетълмента, освен в случай на инструкции за сетълмент FoP;
 - е) номиналната стойност за дългови инструменти или количеството за други финансови инструменти;
 - ж) доставката или получаването на финансови инструменти или парични средства;
 - з) ISIN номера на финансовия инструмент;
 - и) идентификационните данни на участника, който доставя финансовите инструменти или паричните средства;
 - й) идентификационните данни на участника, който получава финансовите инструменти или паричните средства;
 - к) кода за идентифициране на ЦДЦК на контрагента на участника, ако ЦДЦК използват обща инфраструктура за сетълмент, включително при обстоятелствата, посочени в член 30, параграф 5 от Регламент (ЕС) № 909/2014;
 - л) други полета за съгласуване, изисквани от ЦДЦК за улесняване на сетълмента на сделките.
4. В допълнение към посочените в параграф 3 полета ЦДЦК изискват от своите участници да използват в инструкциите за сетълмент поле, указващо вида на сделката въз основа на следната таксономия:
 - а) покупка или продажба на ценни книжа;
 - б) операции по управление на обезпечения;
 - в) операции по предоставяне/вземане в заем на ценни книжа;
 - г) репо сделки;
 - д) други сделки (които могат да бъдат идентифицирани с по-конкретни кодове по ISO, съгласно предвиденото от ЦДЦК).

Член 6

Нива на допустими отклонения

За целите на съгласуването ЦДЦК определят нива на допустими отклонения за сумите на сетълмента.

Нивото на допустимите отклонения представлява максималната разлика между сумите на сетълмента в две съответстващи инструкции за сетълмент, при която съгласуването все пак е допустимо.

За инструкциите за сетълмент в евро нивото на допустимо отклонение на инструкцията за сетълмент е 2 EUR за суми на сетълмента в размер до 100 000 EUR и 25 EUR за суми на сетълмента над 100 000 EUR. За инструкции за сетълмент в други валути нивото на допустимо отклонение на инструкцията за сетълмент е в еквивалентни размери на базата на официалния обменен курс на ЕЦБ, когато има такъв.

Член 7

Механизъм за отмяна

ЦДЦК създават механизъм за двустранна отмяна, който дава възможност на участниците двустранно да отменят съгласувани инструкции за сетълмент, които са част от една и съща сделка.

Член 8

Механизъм за задържане и освобождаване

ЦДЦК създават механизъм за задържане и освобождаване, който се състои от следните два елемента:

- a) механизъм за задържане, който позволява блокиране на всякакви инструкции за сетълмент от страна на издалия инструкцията участник за извършването на сетълмент;
- b) механизъм за освобождаване, който позволява освобождаване на всякакви инструкции за сетълмент, които са били блокирани от издалия инструкцията участник, с цел извършване на сетълмента.

Член 9

Повторно изпълнение

ЦДЦК изпълнява повторно инструкции за сетълмент, по които сетълментът е бил неуспешен, до извършването на сетълмента или докато бъдат двустранно отменени.

Член 10

Частичен сетълмент

ЦДЦК дават възможност за частичен сетълмент на инструкции за сетълмент.

Член 11

Допълнителни механизми и информация

1. ЦДЦК предлагат на участниците възможността да се информират за всякакви инструкции за сетълмент на техни контрагенти или в рамките на един час след първия неуспешен опит за съгласуване на тази инструкция, или незабавно след такъв неуспешен опит, когато въпросният опит е направен в рамките на петчасовия период преди края на предвидената дата за сетълмент или след предвидената дата за сетълмент.
2. ЦДЦК предоставят достъп на участниците до информация в реално време относно статуса на техните инструкции за сетълмент в системата за сетълмент на ценни книжа, включително информация относно:
 - a) всякакви инструкции за сетълмент, за които все още може да бъде извършен сетълмент на предвидената дата за сетълмент;
 - b) неуспешни инструкции за сетълмент, за които повече не може да бъде извършен сетълмент на предвидената дата за сетълмент;
 - в) инструкции за сетълмент, за които е извършен пълен сетълмент;
 - г) инструкции за сетълмент, за които е извършен частичен сетълмент, включително частите от финансовите инструменти или паричните средства, за които е извършен и за които не е извършен сетълмент;
 - д) отменени инструкции за сетълмент, включително информация относно това дали тези инструкции са били отменени от системата или от участника.

3. Информацията в реално време, посочена в параграф 2, включва следното:
 - а) дали инструкцията за сетълмент е била съгласувана;
 - б) дали по инструкцията за сетълмент все още може да бъде извършен частичен сетълмент;
 - в) дали инструкцията за сетълмент е задържана;
 - г) причините, поради които инструкциите са висящи или неуспешни.
4. ЦДЦК предлагат на участниците или брутен сетълмент в реално време през цялото време на всеки работен ден, или най-малкото сетълмент на три групи през един работен ден. Трите групи на сетълмент са разпределени в рамките на работния ден в съответствие с нуждите на пазара и въз основа на искане от комитета на ползвателите на ЦДЦК.

Член 12

Дерогация от някои мерки за предотвратяване на неуспешен сетълмент

1. Членове 8 и 10 не се прилагат, когато управляваната от ЦДЦК система за сетълмент на ценни книжа отговаря на следните условия:
 - а) стойността на случаите на неуспешен сетълмент не надвишава 2,5 млрд. евро годишно;
 - б) процентът на случаите на неуспешен сетълмент, било то на база на броя на инструкциите за сетълмент или на стойността на инструкциите за сетълмент, е под 0,5 % годишно.

Процентът на неуспешен сетълмент на база на броя на инструкциите за сетълмент се изчислява, като се раздели броят на случаите на неуспешен сетълмент на броя на инструкциите за сетълмент, които са вписани в системата за сетълмент на ценни книжа през съответния период.

Процентът на неуспешен сетълмент на база на стойността на инструкциите за сетълмент се изчислява, като се раздели стойността в евро на случаите на неуспешен сетълмент на стойността на инструкциите за сетълмент, които са вписани в системата за сетълмент на ценни книжа през съответния период.

2. Всяка година до 20 януари ЦДЦК преценяват дали са изпълнени посочените в параграф 1 условия и уведомяват компетентния орган за резултатите от тази оценка в съответствие с приложение II.

Когато оценката потвърди, че поне едно от условията, посочени в параграф 1, вече не е приложимо, ЦДЦК прилага член 8 и член 10 в рамките на една година от датата на уведомлението, посочено в първа алинея.

ГЛАВА III

Мерки за справяне с неуспешен сетълмент

Раздел I

Наблюдение на случаите на неуспешен сетълмент

Член 13

Данни за системата за наблюдение на случаите на неуспешен сетълмент

1. ЦДЦК създават система, която им дава възможност да наблюдават броя и стойността на случаите на неуспешен сетълмент за всяка предвидена дата за сетълмент, включително продължителността на всеки случай на неуспешен сетълмент, изразена в работни дни. За всеки случай на неуспешен сетълмент системата събира следната информация:
 - а) причината за неуспешния сетълмент въз основа на информацията, с която разполага ЦДЦК;
 - б) всички ограничения на сетълмента като резервиране, блокиране или заделяне на финансови инструменти или парични средства, вследствие на които въпросните финансови инструменти или парични средства не са на разположение за сетълмент;

- в) вида на засегнатия от неуспешен сетълмент финансов инструмент според следните категории:
- i) прехвърлими ценни книжа съгласно определеното в член 4, параграф 1, точка 44, буква а) от Директива 2014/65/ЕС;
 - ii) държавен дългов инструмент съгласно определеното в член 4, параграф 1, точка 61 от Директива 2014/65/ЕС;
 - iii) прехвърлими ценни книжа съгласно определеното в член 4, параграф 1, точка 44, буква б) от Директива 2014/65/ЕС, различни от държавните дългови инструменти, посочени в подточка ii);
 - iv) прехвърлими ценни книжа съгласно определеното в член 4, параграф 1, точка 44, буква в) от Директива 2014/65/ЕС;
 - v) борсово търгувани фондове (БТФ);
 - vi) дялове в предприятия за колективно инвестиране, различни от БТФ;
 - vii) инструменти на паричния пазар, различни от държавните дългови инструменти, посочени в подточка ii);
 - viii) квоти за емисии;
 - ix) други финансови инструменти;
- г) вида на засегнатата от неуспешен сетълмент сделка според следните категории:
- i) покупка или продажба на финансови инструменти;
 - ii) операции по управление на обезпечения;
 - iii) операции по предоставяне/вземане в заем на ценни книжа;
 - iv) репо сделки;
 - v) други сделки, които могат да бъдат идентифицирани с по-конкретни кодове по ISO, предоставени от ЦЦК;
- д) мястото на търговия и на клиринг на засегнатите финансови инструменти, ако е приложимо;
- е) вида на засегнатата от неуспешен сетълмент инструкция за сетълмент според следните категории:
- i) вътрешна за ЦЦК инструкция за сетълмент, по която и неизправната, и получаващата страна са участници в една и съща система за сетълмент на ценни книжа; или
 - ii) инструкция за сетълмент между ЦЦК, по която неизправната и получаващата страни са участници в две различни системи за сетълмент или един от участниците е ЦЦК;
- ж) вида на засегнатата от неуспешен сетълмент инструкция за сетълмент според следните категории:
- i) инструкции за сетълмент FoP, които включват инструкции за сетълмент, предвиждащи доставка без плащане („DFP“) и получаване без плащане („RFP“);
 - ii) инструкции за сетълмент, предвиждащи доставка срещу плащане („DVP“) и получаване срещу плащане („RVP“);
 - iii) инструкции за сетълмент, предвиждащи доставка с плащане („DWP“) и получаване с плащане („RWP“); или
 - iv) инструкции за плащане, предвиждащи плащане без доставка (PFOD), състоящи се от инструкции за сетълмент, предвиждащи дебит плащане без доставка (DPFOD), и инструкции за сетълмент, предвиждащи кредит плащане без доставка (RPFOD).
- з) вида на сметките за ценни книжа, свързани с неуспешния сетълмент, в това число:
- i) собствена сметка на участник;
 - ii) индивидуална сметка на клиент на участник;
 - iii) обща сметка на клиент на участник;
- и) валутата, в която са деноминирани инструкциите за сетълмент.

2. ЦЦК сключват работни договорености с участниците, посочени в полета 17 и 18 от таблица 1 в приложение I, които оказват най-сериозно въздействие върху техните системи за сетълмент на ценни книжа, и ако е приложимо, със съответните ЦК и места за търговия, за да анализират главните причини за случаите на неуспешен сетълмент.

Член 14

Докладване на случаите на неуспешен сетълмент

1. ЦДЦК предават информацията, посочена в приложение I, на компетентния орган и на съответните органи ежемесечно и до прекратяване на операциите на петия работен ден от следващия месец.

Тази информация включва съответните стойности в евро. Конвертирането на всяка сума в евро се извършва по официалния обменен курс на ЕЦБ за последния ден на отчетния период, когато има такъв официален обменен курс на ЕЦБ.

По искане на компетентния орган ЦДЦК докладват по-често и предоставят допълнителна информация относно случаите на неуспешен сетълмент.

2. Всяка година до 20 януари ЦДЦК докладва пред компетентния орган и пред съответните органи информацията, посочена в приложение II, в това число планираните или предприетите от ЦДЦК и от техните участници мерки за подобряване на ефикасността на сетълмента на управляваната от тях система за сетълмент на ценни книжа.

ЦДЦК редовно наблюдават прилагането на посочените в първа алинея мерки и, при поискване, предоставят на компетентния орган и на съответните органи всички съответни констатации, направени въз основа на това наблюдение.

3. Посочената в параграфи 1 и 2 информация се предоставя в машинно четим формат.

4. Стойността на инструкциите за сетълмент, посочени в приложения I—III, се изчислява по следния начин:

- a) в случай на инструкции за сетълмент срещу плащане, сумата на сетълмента на паричното рамо;
- b) в случай на инструкции за сетълмент без плащане, пазарната стойност на финансовите инструменти, посочени в член 32, параграф 3, или ако не е известна, номиналната стойност на финансовите инструменти.

Член 15

Публично оповестяване на неуспешен сетълмент

ЦДЦК публикуват безплатно на своите уебсайтове посочената в приложение III информация за управяваните от тях системи за сетълмент на ценни книжа, включително съответните стойности в евро.

Конвертирането на всяка една стойност в евро се извършва по официалния обменен курс на ЕЦБ за последния ден на отчетния период, когато има такъв официален обменен курс на ЕЦБ.

Посочената в първа алинея информация се публикува годишно в машинно четим формат и на език, обичайно използван в сферата на международните финанси.

Раздел 2

Парични санкции

Член 16

Изчисляване и налагане на парични санкции

1. ЦДЦК изчислява и налага паричните санкции, посочени в член 7, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 909/2014, за всяка инструкция за сетълмент, по която не е бил извършен сетълмент.

Споменатото в първата алинея изчисление се отнася и за инструкциите за сетълмент, които са били запържани от участник.

Когато се изисква съгласуване в съответствие с член 5, параграф 2, парични санкции се налагат само за съгласувани инструкции за сетълмент.

2. Паричните санкции се изчисляват и налагат в края на всеки работен ден, когато не е извършен сетълмента по инструкцията за сетълмент.

3. Когато инструкцията за сетълмент е била вписана в системата за сетълмент на ценни книжа или е била съгласувана след предвидената дата за сетълмент, паричните санкции се изчисляват и налагат, считано от предвидената дата за сетълмент.

Когато се вписват нови инструкции за сетълмент в системата за сетълмент на ценни книжа за всички недоставени финансови инструменти в съответствие с член 27, параграф 10, член 29, параграф 11 или член 31, параграф 11, паричните санкции се прилагат за новите инструкции за сетълмент от деня, в който тези инструкции се вписват в системата за сетълмент на ценни книжа.

Когато инструкциите за сетълмент са били съгласувани след предвидената дата за сетълмент, паричните санкции за периода между предвидената дата за сетълмент и работния ден преди деня, на който е извършено съгласуването, се заплащат от последния участник, който е вписал или модифицирал съответната инструкция за сетълмент в системата за сетълмент на ценни книжа.

4. ЦДЦК всеки ден предоставят на всеки съответен участник подробности относно изчисляването на санкциите по всяка инструкция за сетълмент, за която не е бил извършен сетълмент, като включват данни за сметката, към която се отнася всяка инструкция за сетълмент, по която не е бил извършен сетълмент.

Член 17

Събиране и разпределяне на парични санкции

1. ЦДЦК начисляват и събират най-малко ежемесечно нетната сума на паричните санкции, които подлежат на плащане от всеки неизправен участник.

Паричните санкции се внасят по специално предназначена за целта парична сметка.

2. ЦДЦК разпределят най-малко ежемесечно нетната сума на паричните санкции, посочени в параграф 1, между получаващите участници, които са засегнати от случаи на неуспешен сетълмент.

Член 18

Разходи, свързани с механизма за санкции

1. ЦДЦК не използва паричните санкции за покриване на разходите, свързани с механизма за санкции.

2. ЦДЦК оповестяват пред участниците подробна информация относно размера на разходите, упоменати в параграф 1.

3. Разходите, свързани с механизма за санкции, се начисляват отделно от ЦДЦК на участниците. Тези разходи не се начисляват на база на брутните санкции, които се отнасят до всеки участник.

Член 19

Механизъм за санкции, когато участникът е ЦК

Когато неизправният или получаващият участник е ЦК, ЦДЦК гарантират следното:

- а) че на ЦК е предоставено изчислението на паричните санкции по представените от ЦК инструкции за сетълмент, за които не е бил извършен сетълмент;
- б) че ЦК събират паричните санкции, посочени в буква а), от клиринговите членове, които са причинили случаите на неуспешен сетълмент;
- в) че ЦК разпределят паричните санкции, посочени в буква б), между клиринговите членове, които са засегнати от случаите на неуспешен сетълмент;
- г) че ЦК докладват ежемесечно пред ЦДЦК относно санкциите, които са събрали и разпредели.

Член 20

ЦДЦК, които използват обща инфраструктура за сетълмент

ЦДЦК, които използват обща инфраструктура за сетълмент, включително ако част от техните услуги или дейности са възложени на външни подизпълнители съгласно посоченото в член 30, параграф 5 от Регламент (ЕС) № 909/2014, създават съвместно механизма за сетълмент, посочен в член 7, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 909/2014, и съвместно управляват реда и условията за изчисляване, начисляване, събиране и разпределяне на паричните санкции в съответствие с настоящия регламент.

Раздел 3

Детайли на процеса на изкупуване

Подраздел 1

Общи разпоредби

Член 21

Невъзможно изкупуване

Изкупуването се счита за невъзможно само когато:

- а) съответните финансови инструменти вече не съществуват;
- б) при сделки, които не подлежат на клиринг от ЦК, неизправният член на място за търговия или неизправната търгуваща страна подлежи на процедура по несъстоятелност.

За целите на буква б) процедура по несъстоятелност означава всяка колективна мярка, предвидена в правото на държава членка или трета държава, за ликвидация на члена на място за търговия или на търгуващата страна, когато такава мярка включва спиране или налагане на ограничения върху прехвърлянията или плащанията.

Член 22

Неефикасен процес на изкупуване

1. За целите на член 7, параграф 4, буква б) от Регламент (ЕС) № 909/2014 следните операции се считат за съставени от няколко сделки:

- а) операции, при които една страна продава финансови инструменти срещу парични средства („първа сделка“), като е налице ангажимент на другата страна да продаде еквивалентни финансови инструменти на първата страна на цена, която е определена или подлежи на определяне („втора сделка“);
- б) операции, при които една страна прехвърля финансови инструменти на друга страна („първа сделка“), като е налице ангажимент на въпросната друга страна да върне еквивалентни финансови инструменти на първата страна („втора сделка“).

2. Когато се прилага параграф 1, процесът на изкупуване се счита за неефективен, ако предвидената дата за сетълмент на втората сделка е насрочена в рамките на 30 работни дни след предвидената дата за сетълмент на първата сделка.

Член 23

Прилагане на частичен сетълмент

1. Когато в последния работен ден от удължения срок, посочен в член 7, параграф 3 от Регламент (ЕС) № 909/2014, част от съответните финансови инструменти са предоставени за доставка на получаващия участник, получаващите и неизправните клирингови членове, членове на място за търговия или търгуващи страни, според случая, извършват частичен сетълмент на първоначалната инструкция за сетълмент, освен ако са изпълнени условията, предвидени в член 12, параграф 1 от настоящия регламент.

2. Разпоредбите на първа алинея не се прилагат, когато съответната инструкция за сетълмент е задържана в съответствие с член 8.

Член 24

Агент по изкупуването

Агентът по изкупуването не е в конфликт на интереси по отношение на изкупуването и извършва изкупуването при най-благоприятните условия за неизправния клирингов член, член на място за търговия или търгуваща страна, според случая, в съответствие с член 27 от Директива 2014/65/ЕС.

Член 25

Договорни споразумения и процедури

1. Страните във веригата за сетълмент сключват договорни споразумения със съответните си контрагенти, в които включват посочените в параграф 2 изисквания за процеса на изкупуване и процедурите, определени в параграф 3.

2. Посочените в параграф 1 договорни споразумения включват изцяло приложимите изисквания, предвидени в член 7 от Регламент (ЕС) № 909/2014 и в членове 26—38 от настоящия регламент. Всяка страна във веригата за сетълмент гарантира, че сключените със съответните ѝ контрагенти договорни споразумения са изпълними във всички съответни юрисдикции.
3. ЦК, клиринговите членове, членовете на място за търговия или търгуващите страни установяват необходимите процедури по извършване на изкупуването и плащане на паричното обезщетение, на разликата в цената и на разходите по изкупуването в рамките на изискваните срокове. Посочените в настоящия член договорни споразумения и процедури включват необходимите разпоредби, за да се гарантира, че съответните страни във веригата за сетълмент получават нужната информация за упражняване на своите права и за изпълнение на задълженията си в съответствие със сроковете, предвидени в членове 26—35 от настоящия регламент.
4. Участниците сключват необходимите договорни споразумения със своите клиенти, за да гарантират, че изискванията по отношение на изкупуването, предвидени в настоящия регламент, са изпълними във всички юрисдикции, към които принадлежат страните във веригата за сетълмент.
5. Изкупените финансови инструменти може да се считат за доставени по смисъла на членове 27, 29 и 31 само когато тези инструменти са получени в управляваната от ЦДЦК система за сетълмент на ценни книжа от получаващите участници, действащи от името на ЦК, получаващите клирингови членове, членове на място за търговия или търгуващи страни.
6. Паричната компенсация, посочена в член 33, и разликата в цената, посочена в член 35, параграф 1, се считат за платени само когато паричното плащане е получено от получаващите участници, действащи от името на ЦК, получаващите клирингови членове, членове на място за търговия или търгуващи страни.

Подраздел 2

Процес на изкупуване за сделки, подлежащи на клиринг от ЦК

Член 26

Първоначална проверка

1. В работния ден, следващ изтичането на удължения срок, ЦК проверяват дали е възможно изкупуване в съответствие с член 21, буква а) за всяка от сделките, които са били обект на клиринг от негова страна.
2. Когато изкупуването е невъзможно според член 21, буква а), ЦК уведомява неизправния клирингов член за размера на паричното обезщетение в съответствие с член 32. Паричното обезщетение се плаща в съответствие с член 33, параграф 1.
3. Когато е възможно изкупуване, тогава се прилага член 27.

Член 27

Процедура на изкупуване и уведомления

1. Когато е възможно изкупуване, ЦК стартира тръжна процедура или назначава агент по изкупуването в работния ден, следващ изтичането на удължения срок, за което уведомява неизправния и получаващия клирингов член.
2. При получаване на уведомлението, посочено в параграф 1, неизправният клирингов член гарантира, че всяка съответна инструкция за сетълмент, която е свързана с неуспешния сетълмент, е задържана.
3. При получаване на уведомлението, посочено в параграф 1, неизправният клирингов член може да достави финансовите инструменти само, както следва:
 - а) на агента по изкупуването, след като е предварително е получил съгласието му;
 - б) на ЦК, когато въпросният неизправен клирингов член е спечелил тръжната процедура.

Преди получаване на уведомлението, посочено в параграф 1, неизправният клирингов член все пак може да достави финансовите инструменти направо на ЦК.

4. ЦК съобщава резултатите от изкупуването на неизправния и на получаващия клирингов член и на съответния ЦДЦК най-късно в последния работен ден на срока, определен в съответствие с член 37.
5. Когато изкупуването е успешно, било то отчасти или изцяло, уведомлението, предвидено в параграф 4, включва количеството и цената на изкупените финансови инструменти.
6. Когато изкупуването е неуспешно, било то отчасти или изцяло, уведомлението, предвидено в параграф 4, включва размера на паричното обезщетение, изчислен в съответствие с член 32, освен ако във въпросното уведомление е посочено, че изкупуването е отложено.
7. Когато изкупуването е отложено, ЦК съобщава резултатите от въпросното отложено изкупуване на неизправния и на получаващия клирингов член и на съответния ЦДЦК най-късно в последния работен ден от срока на отлагане, предвиден в член 38.
8. Когато посоченото в параграф 7 изкупуване е успешно, било то отчасти или изцяло, уведомлението, предвидено в същия параграф, включва количеството и цената на изкупените финансови инструменти.
9. Когато изкупуването, предвидено в параграф 7, е неуспешно, било то отчасти или изцяло, уведомлението, посочено в същия параграф, включва размера на паричното обезщетение, изчислен в съответствие с член 32.
10. ЦК приема и заплаща изкупените финансови инструменти, посочени в параграфи 5 и 8, и гарантира, че в края на всеки работен ден, в който ЦК получава въпросните финансови инструменти, се извършва следното:
 - а) изкупените финансови инструменти се доставят на получаващите клирингови членове;
 - б) инструкциите за сетълмент, свързани с неуспешния сетълмент, се отменят;
 - в) в системата за сетълмент на ценни книжа се вписват нови инструкции за сетълмент за всички недоставени финансови инструменти и ЦДЦК получава необходимата информация за съответното идентифициране на въпросните нови инструкции за сетълмент.
11. ЦК гарантира, че инструкциите за сетълмент, свързани с неуспешния сетълмент, са отменени при плащането на паричното обезщетение, посочено в параграфи 6 и 9, или най-късно на втория работен ден след уведомлението, предвидено в същите параграфи.

Подраздел 3

Процес на изкупуване за сделки, които не подлежат на клиринг от ЦК и се изпълняват на място за търговия

Член 28

Първоначална проверка

1. За сделки, които не подлежат на клиринг от ЦК и се изпълняват на място за търговия, получаващите участници, чрез своите клиенти, уведомяват без неоправдано забавяне получаващите членове на място за търговия за всички случаи на неуспешен сетълмент.
2. При поискване мястото за търговия съобщава на получаващия член на място за търговия кои са неизправните членове на място за търговия. В работния ден, следващ изтичането на удължения срок, получаващият член на място за търговия проверява дали е възможно изкупуване в съответствие с член 21.
3. Ако не е възможно изкупуване в съответствие с член 21, получаващият член на място за търговия уведомява неизправния член на място за търговия за резултатите от проверката и за размера на паричното обезщетение, изчислено в съответствие с член 32. Паричното обезщетение се плаща в съответствие с член 33, параграф 2.
4. Когато е възможно изкупуване, тогава се прилага член 29.

Член 29

Процедура на изкупуване и уведомления

1. Когато изкупуването е възможно, получаващият член на място за търговия назначава агент по изкупуването в работния ден, следващ изтичането на удължения срок, и уведомява неизправния член на място за търговия за това.

2. При получаване на уведомлението, посочено в параграф 1, неизправният член на място за търговия гарантира, че всяка съответна инструкция за сетълмент, която е свързана с неуспешния сетълмент, е задържана.

3. При получаване на уведомлението, посочено в параграф 1, неизправният член на място за търговия може да достави финансовите инструменти на агента по изкупуването, само след като предварително е получил съгласието му.

Преди получаване на уведомлението, посочено в параграф 1, неизправният член на място за търговия все пак може да достави финансовите инструменти направо на получаващия член на място за търговия.

4. Получаващият член на място за търговия съобщава резултатите от изкупуването на неизправния член на място за търговия и на съответния ЦДЦК най-късно в последния работен ден от периода, определен в съответствие с член 37.

5. Когато изкупуването е успешно, било то отчасти или изцяло, уведомлението, предвидено в параграф 4, включва количеството и цената на изкупените финансови инструменти.

6. Когато изкупуването е неуспешно, било то отчасти или изцяло, уведомлението, предвидено в параграф 4, включва размера на паричното обезщетение, изчислен в съответствие с член 32, освен ако във въпросното уведомление е посочено, че изкупуването се отлага.

7. Когато изкупуването е отложено, получаващият член на място за търговия съобщава резултатите от въпросното отложено изкупуване на неизправния член на място за търговия и на съответния ЦДЦК най-късно в последния работен ден от срока на отлагане, посочен в член 38.

8. Когато посоченото в параграф 7 изкупуване е успешно, било то отчасти или изцяло, уведомлението, предвидено в същия параграф, включва количеството и цената на изкупените финансови инструменти.

9. Когато изкупуването, предвидено в параграф 7, е неуспешно, било то отчасти или изцяло, уведомлението, посочено в същия параграф, включва размера на паричното обезщетение, изчислен в съответствие с член 32.

10. Получаващият член на място за търговия приема и заплаща изкупените финансови инструменти, посочени в параграфи 5 и 8.

11. Получаващият и неизправният член на място за търговия гарантират, че в края на всеки работен ден, в който получаващият член на място за търговия получава инструментите, посочени в параграфи 5 и 8, се извършва следното:

- а) инструкциите за сетълмент, свързани с неуспешния сетълмент, се отменят;
- б) в системата за сетълмент на ценни книжа се вписват новите инструкции за сетълмент за всички недоставени финансови инструменти и ЦДЦК получава необходимата информация за съответното идентифициране на въпросните нови инструкции за сетълмент.

12. Неизправният член на място за търговия заплаща паричното обезщетение, посочено в параграфи 6 и 9, в съответствие с член 33, параграф 2.

13. Неизправният и получаващият член на място за търговия гарантират, че съответните инструкции за сетълмент, свързани с неуспешния сетълмент, биват отменени при плащането на паричното обезщетение, посочено в параграфи 6 и 9, или най-късно на втория работен ден след уведомлението за размера на паричното обезщетение.

Подраздел 4

Процес на изкупуване за сделки, които не подлежат на клиринг от ЦК и не се изпълняват на място за търговия

Член 30

Първоначална проверка

1. За сделки, които не подлежат на клиринг от ЦК и не се изпълняват на място за търговия, получаващите участници, чрез своите клиенти, уведомяват без неоправдано забавяне получаващите търгуващи страни за всички случаи на неуспешен сетълмент.

2. В работния ден, следващ изтичането на удължения срок, получаващите търгуващи страни проверяват дали има възможност за изкупуване в съответствие с член 21.

3. Ако няма възможност за изкупуване в съответствие с член 21, получаващите търгуващи страни уведомяват неизправната търгуваща страна за резултатите от проверката и размера на паричното обезщетение, изчислен в съответствие с член 32. Паричното обезщетение се плаща в съответствие с член 33, параграф 2.
4. Ако има възможност за изкупуване, тогава се прилага член 31.

Член 31

Процедура на изкупуване и уведомления

1. Когато има възможност за изкупуване, получаващата търгуваща страна назначава агент по изкупуването в работния ден, следващ изтичането на удължения срок, и уведомява неизправната търгуваща страна за това.
2. При получаването на уведомлението, посочено в параграф 1, неизправната търгуваща страна гарантира, че всяка съответна инструкция за сетълмент, която е свързана с неуспешния сетълмент, е задържана.
3. При получаване на уведомлението, посочено в параграф 1, неизправната търгуваща страна може да достави финансовите инструменти на агента по изкупуването, само след като предварително е получила съгласието му.

Преди получаване на уведомлението, посочено в параграф 1, неизправната търгуваща страна все пак може да достави финансовите инструменти направо на получаващата търгуваща страна.

4. Получаващата търгуваща страна съобщава резултатите от изкупуването на неизправната търгуваща страна най-късно в последния работен ден от приложимия период, определен в съответствие с член 37. Получаващата търгуваща страна гарантира, че съответният ЦДЦК получава съобщената информация без неоправдано забавяне.
5. Когато изкупуването е успешно, било то отчасти или изцяло, уведомлението, предвидено в параграф 4, включва количеството и цената на изкупените финансови инструменти.
6. Когато изкупуването е неуспешно, било то отчасти или изцяло, уведомлението, предвидено в параграф 4, включва размера на паричното обезщетение, изчислен в съответствие с член 32, освен ако във въпросното уведомление е посочено, че изкупуването е отложено.
7. Когато изкупуването е отложено, получаващата търгуваща страна съобщава резултатите от въпросното отложено изкупуване на неизправната търгуваща страна най-късно в последния работен ден от срока на отлагане, посочен в член 38. Получаващата търгуваща страна гарантира, че съответният ЦДЦК получава съобщената информация без неоправдано забавяне.
8. Когато посоченото в параграф 7 изкупуване е успешно, било то отчасти или изцяло, уведомлението, посочено в същия параграф, включва количеството и цената на изкупените финансови инструменти.
9. Когато изкупуването, предвидено в параграф 7, е неуспешно, било то отчасти или изцяло, уведомлението, посочено в същия параграф, включва размера на паричното обезщетение, изчислен в съответствие с член 32.
10. Получаващата търгуваща страна приема и заплаща изкупените финансови инструменти, посочени в параграфи 5 и 8.
11. Получаващата и неизправната търгуваща страна гарантират, че в края на всеки работен ден, в който получаващата търгуваща страна получава инструментите, посочени в параграфи 5 и 8, се извършва следното:
 - а) инструкциите за сетълмент, свързани с неуспешния сетълмент, се отменят;
 - б) в системата за сетълмент на ценни книжа се вписват новите инструкции за сетълмент за всички недоставени финансови инструменти и ЦДЦК получава необходимата информация за съответното идентифициране на въпросните нови инструкции за сетълмент.
12. Неизправната търгуваща страна заплаща паричното обезщетение, посочено в параграфи 6 и 9, в съответствие с член 33, параграф 3.

13. Неизправната и получаващата търгуваща страна гарантират, че съответните инструкции за сетълмент, свързани с неуспешния сетълмент, се отменят при плащане на паричното обезщетение, посочено в параграфи 6 и 9, или най-късно на втория работен ден след уведомлението за размера на въпросното паричното обезщетение.

Подраздел 5

Изчисляване и плащане на паричното обезщетение, на разходите по изкупуването и на съответната разлика в цената

Член 32

Изчисляване на паричното обезщетение

1. Паричното обезщетение, което подлежи на плащане в съответствие с член 7, параграф 7 от Регламент (ЕС) № 909/2014, се изчислява по един от следните начини:

- а) за инструкции за сетълмент срещу плащане — разликата между пазарната стойност на съответните финансови инструменти в работния ден преди плащането на паричното обезщетение и сумата на сетълмента, посочена в инструкцията за сетълмент, за която не е бил извършен сетълмент, когато въпросната сума на сетълмента е по-ниска от тази пазарна стойност;
- б) за инструкции за сетълмент без плащане — разликата между пазарната стойност на съответните пазарни инструменти в работния ден преди плащането на паричното обезщетение и пазарната стойност на въпросните финансови инструменти в деня на сделката за тях, когато пазарната стойност на тези финансови инструменти в деня на сделката за тях е по-ниска, отколкото в работния ден преди плащането на паричното обезщетение.

2. Когато все още не е включено в пазарната стойност на финансовия инструмент, паричното обезщетение, което подлежи на плащане в съответствие с член 7, параграф 7 от Регламент (ЕС) № 909/2014, включва компонент, отразяващ изменението на обменните курсове, както и корпоративни права и начислена лихва.

3. Посочената в параграф 1 пазарна стойност се определя, както следва:

- а) за финансовите инструменти, посочени в член 3, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 600/2014 на Европейския парламент и на Съвета⁽¹⁾, допуснати за търговия на място за търговия в рамките на Съюза, стойността, определена въз основа на цената при закриването на най-относимия пазар по отношение на ликвидността съгласно член 4, параграф 6, буква б) от същия регламент;
- б) за финансови инструменти, допуснати за търговия на място за търговия в рамките на Съюза, различни от посочените в буква а), стойността, определена въз основа на цената при закриването на мястото за търговия с най-голям оборот в рамките на Съюза;
- в) за финансови инструменти, различни от посочените в букви а) и б), стойността, определена въз основа на цената, изчислена с помощта на предварително определена методика, одобрена от компетентния орган на ЦДЦК, която използва критерии, свързани с пазарни данни, в това число пазарни цени, които са достъпни за местата за търговия и инвестиционните посредници.

4. Посочената в параграф 1 пазарна стойност и компонентът, отразяващ изменението на обменните курсове, корпоративните права и начислената лихва, посочени в параграф 2, се оповестяват с подробна разбивка пред клиринговите членове, членовете на място за търговия и търгуващите страни.

Член 33

Плащане на паричното обезщетение

1. За сделки, които подлежат на клиринг от ЦК, ЦК събира паричното обезщетение от неизправните клирингови членове и плаща паричното обезщетение на получаващите клирингови членове.

2. Когато сделките не подлежат на клиринг от ЦК, но се изпълняват на място за търговия, неизправните членове на място за търговия плащат паричното обезщетение на получаващите членове на място за търговия.

3. Когато сделките не подлежат на клиринг от ЦК и не се изпълняват на място за търговия, неизправните търгуващи страни плащат паричното обезщетение на получаващите търгуващи страни.

⁽¹⁾ Регламент (ЕС) № 600/2014 на Европейския парламент и на Съвета от 15 май 2014 г. относно пазарите на финансови инструменти и за изменение на Регламент (ЕС) № 648/2012 (ОВ L 173, 12.6.2014 г., стр. 84).

Член 34**Плащане на разходите по изкупуването**

Сумите, посочени в член 7, параграф 8 от Регламент (ЕС) № 909/2014, се плащат от неизправните клирингови членове, неизправните членове на място за търговия или неизправните търгуващи страни, според случая.

Член 35**Плащане на разликата в цената**

1. Когато цената на финансовите инструменти, посочени в член 5, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 909/2014, договорена при сключването на сделката, е по-ниска от цената, която реално е платена за тези финансови инструменти в съответствие с член 27, параграф 10, член 29, параграф 10 и член 31, параграф 10, неизправните клирингови членове, неизправните членове на място за търговия или неизправните търгуващи страни заплащат разликата в цената на ЦК, получаващите членове на място за търговия или получаващите търгуващи страни, според случая.

Когато сделките подлежат на клиринг от ЦК, ЦК събира разликата в цената, посочена в първа алинея, от неизправните клирингови членове и я плаща на получаващите клирингови членове.

2. Когато цената на акциите, договорена при сключването на сделката, е по-висока от реално платената цена за тези акции съгласно член 27, параграф 10, член 29, параграф 10 и член 31, параграф 10, тогава съответната разлика, посочена в член 7, параграф 6 от Регламент (ЕС) № 909/2014, се счита за платена.

Раздел 4**Срокове за процеса на изкупуване****Член 36****Удължени срокове**

В съответствие с член 7, параграф 4, буква а) от Регламент (ЕС) № 909/2014 удълженият срок за финансовите инструменти, посочени в член 5, параграф 1 от Регламент (ЕС) № 909/2014, се увеличава от четири на седем работни дни за всички финансови инструменти, различни от акции, за които има ликвиден пазар в съответствие с член 2, параграф 1, точка 17, буква б) от Регламент (ЕС) № 600/2014.

Член 37**Срокове за доставка на финансови инструменти**

След процеса на изкупуване финансовите инструменти, посочени в член 5, параграф 1, първа алинея от Регламент (ЕС) № 909/2014, се доставят на получаващите участници, които действат от името на ЦК, получаващите клирингови членове, членове на място за търговия или търгуващите страни, в следните срокове:

- а) четири работни дни след удължения срок, посочен в член 36, за акции, за които има ликвиден пазар;
- б) седем работни дни след удължения срок, посочен в член 36, за финансови инструменти, различни от акциите, за които има ликвиден пазар;
- в) седем работни дни след удължения срок, посочен в член 7, параграф 3, втора алинея от Регламент (ЕС) № 909/2014, за финансови инструменти, които се търгуват на пазари за растеж на МСП;
- г) когато посочените в буква а) акции се търгуват на пазари за растеж на МСП, тогава се прилага буква в).

Член 38**Продължителност на отлагането на изкупуването**

Когато ЦК, получаващият член на място за търговия или получаващата търгуваща страна отложи изкупуването, продължителността на срока на отлагане, посочен в член 7, параграф 7 от Регламент (ЕС) № 909/2014, се определя в съответствие със сроковете, посочени в член 37.

Раздел 5

Системно недоставяне

Член 39

Многократно и системно недоставяне на ценни книжа

1. Счита се, че участникът многократно и системно не доставя в системата за сетълмент на ценни книжа, както е посочено в член 7, параграф 9 от Регламент (ЕС) № 909/2014, когато неговата норма на ефикасност на сетълмента, определена въз основа на броя или на стойността на инструкциите за сетълмент, е най-малко с 15 % по-ниска от нормата на ефикасност на сетълмента на въпросната система за сетълмент на ценни книжа в продължение на най-малко съответния брой дни през предходните 12 месеца.

Съответният брой дни се определя за всеки участник като 10 % от броя на дните с активност на този участник в системата за сетълмент на ценни книжа през предходните 12 месеца.

2. Когато се изчислява нормата на ефикасност на сетълмента на даден участник, следва да се имат предвид единствено случаите на неуспешен сетълмент, причинени от въпросния участник.

Раздел 6

Информация за сетълмента

Член 40

Информация за сетълмента, предоставяна на ЦК и на местата за търговия

Информацията за сетълмента, посочена в член 7, параграф 10, втора алинея от Регламент (ЕС) № 909/2014, включва идентифициране на съответните сделки, на участниците и на съответните инструкции за сетълмент. Тази информация се основава на информацията в управляваната от ЦДЦК система за сетълмент на ценни книжа.

Член 41

Информация за сетълмента при липсата на пряко подаване на данни за сделки от мястото за търговия

За сключени на място за търговия сделки, които не подлежат на клиринг от ЦК, и при липсата на пряко подаване на данни за сделки от мястото за търговия на ЦДЦК, участниците посочват мястото за търговия и сделките в своите инструкции за сетълмент. Ако такава информация липсва, ЦДЦК счита, че сделките не са сключени на място за търговия.

ГЛАВА IV

Заключителни разпоредби

Член 42

Настоящият регламент влиза в сила 24 месеца след деня на публикуването му в *Официален вестник на Европейския съюз*.

Настоящият регламент е задължителен в своята цялост и се прилага пряко във всички държави членки.

Съставено в Брюксел на 25 май 2018 година.

За Комисията
Председател
Jean-Claude JUNCKER

ПРИЛОЖЕНИЕ I

Таблица 1

Обща информация за случаите на неуспешен сетълмент, които се докладват ежемесечно от ЦДЦК пред компетентните органи и съответните органи

№	Докладвани данни	Формат
1.	Код на държавата за юрисдикцията, в която е установен ЦДЦК	Двубуквен код на държавата по ISO 3166
2.	Система за сетълмент на ценни книжа, управлявана от ЦДЦК	Свободен текст
3.	Дата и час на доклада (на ЦДЦК пред компетентния орган/съответния орган)	Формат на датата съгласно ISO 8601. Формат на часа съгласно координираното универсално време (UTC) — YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ
4.	Отчетен период: начална и крайна дата на периода, за който се отнася докладът	Дата по ISO 8601 във формат ГГГ-ММ-ДД-ГГГ-ММ-ДД
5.	Идентификационен код на правния субект на ЦДЦК	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака.
6.	Фирма/търговско наименование на ЦДЦК	Свободен текст
7.	Име на лицето, отговарящо за изпратения от ЦДЦК доклад	Свободен текст
8.	Длъжност на лицето, отговарящо за изпратения от ЦДЦК доклад	Свободен текст
9.	Телефонен номер на лицето, отговарящо за изпратения от ЦДЦК доклад	Може да се използват само цифрови знаци. Телефонният номер трябва да бъде посочен с кода на държавата и кода на областта/града. Не може да се използват специални знаци.
10.	Адрес на електронна поща на лицето, отговарящо за изпратения от ЦДЦК доклад	Адресът на електронна поща трябва да бъде посочен, като се използват стандартните обозначения за адрес на електронна поща.
11.	Брой на инструкциите за сетълмент през обхванатия от доклада период	До 20 цифрови знака, отчетени като цяло число без десетични числа.
12.	Брой на случаите на неуспешен сетълмент през обхванатия от доклада период (обхванати са случаите на неуспешен сетълмент както поради липса на ценни книжа, така и на парични средства)	До 20 цифрови знака, отчетени като цяло число без десетични числа.
13.	Процент на случаите на неуспешен сетълмент на база на обема (брой на случаите на неуспешен сетълмент/брой на инструкциите за сетълмент през обхванатия от доклада период) (обхванати са случаите на неуспешен сетълмент както поради липса на ценни книжа, така и на парични средства)	Процентна стойност до 2 знака след десетичната запетая.

№	Докладвани данни	Формат	
14.	Процент на неуспешен сетълмент на база на стойността (в EUR) (стойност на неуспешен сетълмент/стойност на инструкции за сетълмент през обхванатия в доклада период) (обхванати са случаите на неуспешен сетълмент както поради липса на ценни книжа, така и на парични средства)	Процентна стойност до 2 знака след десетичната запетая.	
15.	Стойност на инструкциите за сетълмент (в EUR) през обхванатия от доклада период	До 20 цифрови знака, включително десетични числа. Попълва се най-малко един знак преди и един знак след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак.	
16.	Стойност на случаите на неуспешен сетълмент (в EUR) през обхванатия от доклада период (обхванати са случаите на неуспешен сетълмент както поради липса на ценни книжа, така и на парични средства)	До 20 цифрови знака, включително десетични числа. Попълва се най-малко един знак преди и един знак след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак.	
17.	Първите 10 участници с най-високи проценти на случаи на неуспешен сетълмент през обхванатия от доклада период (въз основа на броя на инструкциите за сетълмент)	За всеки участник, който е идентифициран с ИКПС	
		ИКПС на участник	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака.
		Общ брой на инструкциите за сетълмент на участник	До 20 цифрови знака, отчетени като цяло число без десетични числа.
		Брой на случаите на неуспешен сетълмент на участник	До 20 цифрови знака, отчетени като цяло число без десетични числа.
		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	Процентна стойност до 2 знака след десетичната запетая.
		Обща стойност (в EUR) на инструкциите за сетълмент на участник	До 20 цифрови знака, включително десетични числа. Попълва се най-малко един знак преди и един знак след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак.
		Стойност (в EUR) на случаите на неуспешен сетълмент на участник	До 20 цифрови знака, включително десетични числа. Попълва се най-малко един знак преди и един знак след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак.
Процент на случаите на неуспешен сетълмент	Процентна стойност до 2 знака след десетичната запетая.		
18.	Първите 10 участници с най-високи проценти на случаите на неуспешен сетълмент през обхванатия от доклада период (въз основа на стойността (в EUR) на инструкциите за сетълмент)	За всеки участник, който е идентифициран с ИКПС:	
		ИКПС на участник	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака.

№	Докладвани данни	Формат	
		Обща стойност (EUR) на инструкциите за сепълмент на участник	До 20 цифрови знака, включително десетични числа. Попълва се най-малко един знак преди и един знак след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак.
		Стойност (в EUR) на случаите на неуспешен сепълмент на участник	До 20 цифрови знака, включително десетични числа. Попълва се най-малко един знак преди и един знак след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак.
		Процент на случаите на неуспешен сепълмент	Процентна стойност до 2 знака след десетичната запетая.
		Общ брой на инструкциите за сепълмент на участник	До 20 цифрови знака, отчетени като цяло число без десетични числа.
		Брой на случаите на неуспешен сепълмент на участник	До 20 цифрови знака, отчетени като цяло число без десетични числа.
		Процент на случаите на неуспешен сепълмент	Процентна стойност до 2 знака след десетичната запетая.
19.	Брой на инструкциите за сепълмент по валута, в която са деноминирани инструкциите за сепълмент, през обхванатия от доклада период	Обемът за всеки 3-буквен код на валута по ISO 4217 се изразява с до 20 цифрови знака, които се отчитат като цели числа без знаци след десетичната запетая.	
20.	Брой на случаите на неуспешен сепълмент по валута, в която са деноминирани инструкциите за сепълмент, през обхванатия от доклада период	Обемът за всеки 3-буквен код на валута по ISO 4217 се изразява с до 20 цифрови знака, които се отчитат като цели числа без знаци след десетичната запетая.	
21.	Процент на случаите на неуспешен сепълмент по валута, в която са деноминирани инструкциите за сепълмент, на база на обема (брой на случаите на неуспешен сепълмент/брой на инструкциите за сепълмент по валута през обхванатия от доклада период)	Процентът за всеки 3-буквен код на валута по ISO 4217 се изразява като процентна стойност до 2 знака след десетичната запетая.	
22.	Стойност на инструкциите за сепълмент по валута, в която са деноминирани инструкциите за сепълмент, през обхванатия от доклада период	Стойността за всеки 3-буквен код на валута по ISO 4217 се изразява с до 20 цифрови знака, вкл. знаци след десетичната запетая. Попълва се най-малко един знак преди и един знак след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак.	
23.	Стойност на случаите на неуспешен сепълмент по валута, в която са деноминирани инструкциите за сепълмент, през обхванатия от доклада период	Стойността за всеки 3-буквен код на валута по ISO 4217 се изразява с до 20 цифрови знака, вкл. знаци след десетичната запетая. Попълва се най-малко един знак преди и един знак след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак.	

№	Докладвани данни	Формат
24.	Процент на случаите на неуспешен сетълмент по валута, в която са деноминирани инструкциите за сетълмент, на база на стойността (стойност на случаите на неуспешен сетълмент/стойност на инструкциите за сетълмент по валута през обхванатия от доклада период)	Процентът за всеки 3-буквен код на валута по ISO 4217 се изразява като процентна стойност до 2 знака след десетичната запетая.
25.	Брой на инструкциите за сетълмент за всеки вид от финансовите инструменти през обхванатия от доклада период	За всеки вид финансови инструменти: До 20 цифрови знака, отчетени като цяло число без десетични числа.
26.	Брой на случаите на неуспешен сетълмент (обхванати са случаите на неуспешен сетълмент както поради липса на ценни книжа, така и на парични средства) за всеки вид финансови инструменти през обхванатия от доклада период	За всеки вид финансови инструменти: До 20 цифрови знака, отчетени като цяло число без десетични числа.
27.	Процент на случаите на неуспешен сетълмент за всеки вид финансови инструменти на база на обема (брой на случаите на неуспешен сетълмент/брой на инструкциите за сетълмент за всеки вид финансови инструменти през обхванатия от доклада период)	Процентът за всеки вид от финансовите инструменти се изразява като процентна стойност до 2 знака след десетичната запетая.
28.	Стойност (в EUR) на инструкциите за сетълмент за всеки вид от финансовите инструменти	Стойността за всеки вид от финансовите инструменти се изразява с до 20 цифрови знака, вкл. знаци след десетичната запетая. Попълва се най-малко един знак преди и един знак след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак.
29.	Стойност (в EUR) за случаите на неуспешен сетълмент (обхванати са случаите на неуспешен сетълмент както поради липса на ценни книжа, така и на парични средства) за всеки вид финансови инструменти	Стойността за всеки вид от финансовите инструменти се изразява с до 20 цифрови знака, вкл. знаци след десетичната запетая. Попълва се най-малко един знак преди и един знак след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак.
30.	Процент на случаите на неуспешен сетълмент за всеки вид финансов инструмент на база на стойността (стойност на случаите на неуспешен сетълмент/стойност на инструкциите за сетълмент за всеки вид финансов инструмент през обхванатия от доклада период)	Процентът за всеки вид от финансовите инструменти се изразява като процентна стойност до 2 знака след десетичната запетая.
31.	Брой на инструкциите за сетълмент за всеки вид от сделките през обхванатия от доклада период	Обемът за всеки вид от сделките се изразява с до 20 цифрови знака, които се отчитат като цели числа без знаци след десетичната запетая.
32.	Брой на случаите на неуспешен сетълмент (обхванати са случаите на неуспешен сетълмент както поради липса на ценни книжа, така и на парични средства) за всеки вид от сделките през обхванатия от доклада период	Обемът за всеки вид от сделките се изразява с до 20 цифрови знака, които се отчитат като цели числа без знаци след десетичната запетая.

№	Докладвани данни	Формат
33.	Процент на случаите на неуспешен сетълмент за всеки вид от сделките на база на обема (брой на случаите на неуспешен сетълмент/брой на инструкциите за сетълмент за всеки вид от сделките през обхванатия от доклада период)	Процентът за всеки вид от сделките се изразява като процентна стойност до 2 знака след десетичната запетая.
34.	Стойност (в EUR) на инструкциите за сетълмент за всеки вид от сделките	Стойността за всеки вид от сделките се изразява с до 20 цифрови знака, вкл. знаци след десетичната запетая. Попълва се най-малко един знак преди и един знак след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак.
35.	Стойността (в EUR) за случаите на неуспешен сетълмент (обхванати са случаите на неуспешен сетълмент както поради липса на ценни книжа, така и на парични средства) за всеки вид от сделките	Стойността за всеки вид от сделките се изразява с до 20 цифрови знака, вкл. знаци след десетичната запетая. Попълва се най-малко един знак преди и един знак след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак.
36.	Процент на случаите на неуспешен сетълмент за всеки вид от сделките на база на стойността (стойност на случаите на неуспешен сетълмент/стойност на инструкциите за сетълмент за всеки вид от сделките през обхванатия от доклада период)	Процентът за всеки вид от сделките се изразява като процентна стойност до 2 знака след десетичната запетая.
37.	Първите 20 ISIN номера, които са обект на неуспешен сетълмент, въз основа на обема на случаите на неуспешен сетълмент;	ISIN код
38.	Първите 20 ISIN номера, които са обект на неуспешен сетълмент, въз основа на стойността (в EUR) на случаите на неуспешен сетълмент.	ISIN номер
39.	Общ брой на санкциите по член 7, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 909/2014, наложени от ЦДЦК	До 20 цифрови знака, отчетени като цяло число без десетични числа.
40.	Обща стойност (в EUR) на санкциите по член 7, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 909/2014, наложени от ЦДЦК	До 20 цифрови знака, включително десетични числа. Попълва се най-малко един знак преди и един знак след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак.
41.	Средна продължителност на случаите на неуспешен сетълмент като брой дни (разликата между реалната дата на сетълмента и предвидената дата за сетълмент, претеглена спрямо стойността на неуспешния сетълмент)	Брой дни, отчетени като число с един знак след десетичната запетая.
42.	Основни причини за случаите на неуспешен сетълмент	Свободен текст
43.	Мерки за подобряване на ефикасността на сетълмента	Свободен текст

Таблица 2

Дневни данни за неуспешен сетълмент, които се докладват от ежемесечно ЦДЦК пред компетентните органи и съответните органи

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)															
Вид на финансовите инструменти	Вид сделка	Вътрешни/междусистемни	Вид на инструкцията	Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
				Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
				Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)
Прехвърлими ценни книжа по член 4, параграф 1, точка 44, буква а) от Директива 2014/65/ЕС	Покупка или продажба на финансови инструменти	Вътрешни за ЦДЦК	DVP ⁽¹⁾												
			DWP ⁽²⁾												
			PFOD ⁽³⁾												
			FoP ⁽⁴⁾												
		Между ЦДЦК	DVP												
			DWP												
			PFOD												
			FoP												
	Операции по управление на обезпеченията	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
			DWP												
			PFOD												
			FoP												
Между ЦДЦК		DVP													
		DWP													

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)

Вид на финансовите инструменти	Вид сделка	Вътрешни/междусистемни	Вид на инструкцията	Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
				Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
				Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)
Предоставяне/ взимане в заем на ценни книжа			PFOD												
			FoP												
	Вътрешни за ЦДЦК	DVP	DVP												
			DWP												
			PFOD												
			FoP												
		Между ЦДЦК	DVP												
			DWP												
			PFOD												
			FoP												
	Обратно изкупуване	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
			DWP												
			PFOD												
			FoP												
		Между ЦДЦК	DVP												
			DWP												
PFOD															
FoP															

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)

Вид на финансовите инструменти	Вид сделка	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията	Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
				Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
				Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)
Операции по управление на обезпеченията	Вътрешни за ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Между ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
Предоставяне/ взимане в заем на ценни книжа	Вътрешни за ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Между ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)

Вид на финансовите инструменти	Вид сделка	Вътрешни/междусистемни	Вид на инструкцията	Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства						
				Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		
				Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	
Обратно изкупуване	Вътрешни за ЦДЦК	DVP														
			DWP													
				PFOD												
					FoP											
		Между ЦДЦК				DVP										
			DWP													
				PFOD												
					FoP											
	Други сделки	Вътрешни за ЦДЦК				DVP										
			DWP													
				PFOD												
					FoP											
Между ЦДЦК		DVP														
			DWP													
				PFOD												
					FoP											

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)

Вид на финансовите инструменти	Вид сделка	Вътрешни/междусистемни	Вид на инструкцията	Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
				Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
				Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)
Предоставяне/ взимане в заем на ценни книжа	Вътрешни за ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Между ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Обратно изкупуване	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
			DWP												
			PFOD												
			FoP												
Между ЦДЦК		DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)

Вид на финансовите инструменти	Вид сделка	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията	Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
				Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
				Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)
Операции по управление на обезпеченията	Вътрешни за ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Между ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
Предоставяне/ взимане в заем на ценни книжа	Вътрешни за ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Между ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)

Вид на финансовите инструменти	Вид сделка	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията	Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
				Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
				Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)
Борсово търгувани фондове, както са определени в член 4, параграф 1, точка 46 от Директива 2014/65/ЕС	Покупка или продажба на финансови инструменти	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
			DWP												
			PFOD												
			FoP												
		Между ЦДЦК	DVP												
			DWP												
			PFOD												
			FoP												
	Операции по управление на обезпеченията	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
			DWP												
			PFOD												
			FoP												
Между ЦДЦК		DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)

Вид на финансовите инструменти	Вид сделка	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията	Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
				Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
				Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)
Предоставяне/ взимане в заем на ценни книжа	Вътрешни за ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Между ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
Обратно изкупуване	Вътрешни за ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Между ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)

Вид на финансовите инструменти	Вид сделка	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията	Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
				Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
				Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)
Операции по управление на обезпеченията	Вътрешни за ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Между ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
Предоставяне/ взимане в заем на ценни книжа	Вътрешни за ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Между ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)

Вид на финансовите инструменти	Вид сделка	Вътрешни/междусистемни	Вид на инструкцията	Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства						
				Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		
				Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	
Обратно изкупуване	Вътрешни за ЦДЦК	DVP														
			DWP													
				PFOD												
					FoP											
		Между ЦДЦК				DVP										
			DWP													
				PFOD												
					FoP											
	Други сделки	Вътрешни за ЦДЦК				DVP										
			DWP													
				PFOD												
					FoP											
Между ЦДЦК		DVP														
			DWP													
				PFOD												
					FoP											

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)

Вид на финансовите инструменти	Вид сделка	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията	Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
				Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
				Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)
Предоставяне/ взимане в заем на ценни книжа	Вътрешни за ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Между ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
Обратно изкупуване	Вътрешни за ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Между ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)

Вид на финансовите инструменти	Вид сделка	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията	Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
				Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
				Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)
Операции по управление на обезпеченията	Вътрешни за ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Между ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
Предоставяне/ взимане в заем на ценни книжа	Вътрешни за ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Между ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)

Вид на финансовите инструменти	Вид сделка	Вътрешни/междусистемни	Вид на инструкцията	Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства						
				Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		
				Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	
Обратно изкупуване	Вътрешни за ЦДЦК	DVP														
			DWP													
				PFOD												
					FoP											
		Между ЦДЦК				DVP										
			DWP													
				PFOD												
					FoP											
	Други сделки	Вътрешни за ЦДЦК				DVP										
			DWP													
				PFOD												
					FoP											
		Между ЦДЦК				DVP										
			DWP													
				PFOD												
					FoP											

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)

Вид на финансовите инструменти	Вид сделка	Вътрешни/ междусистемни	Вид на инструкцията	Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
				Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
				Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)
Други финансови инструменти	Покупка или продажба на финансови инструменти	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
			DWP												
			PFOD												
			FoP												
		Между ЦДЦК	DVP												
			DWP												
			PFOD												
			FoP												
	Операции по управление на обезпеченията	Вътрешни за ЦДЦК	DVP												
			DWP												
			PFOD												
			FoP												
Между ЦДЦК		DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)

Вид на финансовите инструменти	Вид сделка	Вътрешни/междусистемни	Вид на инструкцията	Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
				Случаи на неуспешен сепълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сепълмент		Случаи на неуспешен сепълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сепълмент	
				Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)
Предоставяне/ взимане в заем на ценни книжа	Вътрешни за ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Между ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
Обратно изкупуване	Вътрешни за ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Между ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													

Дата (за всеки отчетен ден през месеца)

Вид на финансовите инструменти	Вид сделка	Вътрешни/междусистемни	Вид на инструкцията	Недоставяне на ценни книжа						Недоставяне на парични средства					
				Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент		Случаи на неуспешен сетълмент		Общо инструкции		Процент на случаите на неуспешен сетълмент	
				Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)	Обем	Стойност (EUR)
Други сделки	Вътрешни за ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													
	Между ЦДЦК	DVP													
		DWP													
		PFOD													
		FoP													

(1) Обхващат се инструкции за сетълмент, предвиждащи DVP и RVP

(2) Обхващат се инструкции за сетълмент, предвиждащи DWP и RWP

(3) Обхващат се инструкции за сетълмент, предвиждащи DPFOD и CPFOD

(4) Обхващат се инструкции за сетълмент, предвиждащи DFP и RFP

ПРИЛОЖЕНИЕ II

Информация за случаите на неуспешен сетълмент, които се докладват от ЦДЦК пред компетентните органи и съответните органи на годишна база

Таблица 1

№	Докладвани данни	Формат
1.	Код на държавата за юрисдикцията, в която е установен ЦДЦК	Двубуквен код на държавата по ISO 3166
2.	Система за сетълмент на ценни книжа, управлявана от ЦДЦК	Свободен текст
3.	Дата и час на доклада (на ЦДЦК пред компетентния орган/съответния орган)	Формат на датата съгласно ISO 8601. Формат на часа съгласно координираното универсално време (UTC) — YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ
4.	Отчетен период: начална и крайна дата на периода, за който се отнася докладът	Дата по ISO 8601 във формат ГГГ-ММ-ДД-ГГГ-ММ-ДД
5.	Идентификационен код на правния субект на ЦДЦК	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака.
6.	Фирма/търговско наименование на ЦДЦК	Свободен текст
7.	Име на лицето, отговарящо за изпратения от ЦДЦК доклад	Свободен текст
8.	Длъжност на лицето, отговарящо за изпратения от ЦДЦК доклад	Свободен текст
9.	Телефонен номер на лицето, отговарящо за изпратения от ЦДЦК доклад	Може да се използват само цифрови знаци. Телефонният номер трябва да бъде посочен с кода на държавата и кода на областта/града. Не може да се използват специални знаци.
10.	Адрес на електронна поща на лицето, отговарящо за изпратения от ЦДЦК доклад	Адресът на електронна поща трябва да бъде посочен, като се използват стандартните обозначения за адрес на електронна поща.
11.	Мерки за подобряване на ефикасността на сетълмента	Свободен текст
12.	Основни причини за случаите на неуспешен сетълмент (годишно обобщение на причините за неуспешен сетълмент, включени в месечните отчети)	Свободен текст
13.	Годишен обем на инструкциите за сетълмент	До 20 цифрови знака, отчетени като цяло число без десетични числа.
14.	Годишен обем на случаите на неуспешен сетълмент (обхванати са случаите на неуспешен сетълмент както поради липса на ценни книжа, така и на парични средства)	До 20 цифрови знака, отчетени като цяло число без десетични числа.
15.	Годишен процент на случаите на неуспешен сетълмент на база на обема (годишен брой на случаите на неуспешен сетълмент/годишен брой на инструкциите за сетълмент) (обхванати са случаите на неуспешен сетълмент както поради липса на ценни книжа, така и на парични средства)	Процентна стойност до 2 знака след десетичната запетая.
16.	Годишна стойност (в EUR) на инструкциите за сетълмент	До 20 цифрови знака, включително десетични числа. Попълва се най-малко един знак преди и един знак след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак.

№	Докладвани данни	Формат
17.	Годишна стойност (в EUR) на случаите на неуспешен сетълмент (обхванати са случаите на неуспешен сетълмент както поради липса на ценни книжа, така и на парични средства)	До 20 цифрови знака, включително десетични числа. Попълва се най-малко един знак преди и един знак след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак.
18.	Годишен процент на случаите на неуспешен сетълмент на база на стойността (годишна стойност на случаите на неуспешен сетълмент/годишна стойност на инструкциите за сетълмент) (обхванати са случаите на неуспешен сетълмент както поради липса на ценни книжа, така и на парични средства)	Процентна стойност до 2 знака след десетичната запетая.
19.	Отговарят ли на условията за прилагане на дерогация по член 12 от Делегирания регламент за дисциплина при сетълмента, вкл. юрисдикцията?	ДА/НЕ Свободен текст

ПРИЛОЖЕНИЕ III

Доклад за случаите на неуспешен сетълмент, които се оповестяват на годишна база

Таблица 1

№	Данни, които се публикуват	Формат
1.	Отчетен период	Дата по ISO 8601 във формат ГГГГ-ММ-ДД-ГГГГ-ММ-ДД
2.	Идентификационен код на правния субект на ЦДЦК	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442. Код с 20 буквено-цифрови знака.
3.	Система за сетълмент на ценни книжа, управлявана от ЦДЦК	Свободен текст
4.	Брой на инструкциите за сетълмент през обхванатия от доклада период	До 20 цифрови знака, отчетени като цяло число без десетични числа.
5.	Стойност (в EUR) на инструкциите за сетълмент през обхванатия от доклада период	До 20 цифрови знака, включително десетични числа. Попълва се най-малко един знак преди и един знак след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак.

Данни относно недоставяне на ценни книжа

6.	Брой на случаите на неуспешен сетълмент поради недоставяне на ценни книжа	До 20 цифрови знака, отчетени като цяло число без десетични числа.
7.	Стойност (в EUR) на случаите на неуспешен сетълмент поради недоставяне на ценни книжа	До 20 цифрови знака, включително десетични числа. Попълва се най-малко един знак преди и един знак след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак.
8.	Процент на случаите на неуспешен сетълмент на база обема на инструкциите за сетълмент	Процентна стойност до 2 знака след десетичната запетая.
9.	Процент на неуспешен сетълмент на база стойност на инструкциите за сетълмент	Процентна стойност до 2 знака след десетичната запетая.

Данни относно недоставяне на парични средства

10.	Брой на случаите на неуспешен сетълмент поради недоставяне на парични средства	До 20 цифрови знака, отчетени като цяло число без десетични числа.
11.	Стойност (в EUR) на случаите на неуспешен сетълмент поради недоставяне на парични средства	До 20 цифрови знака, включително десетични числа. Попълва се най-малко един знак преди и един знак след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак.
12.	Процент на случаите на неуспешен сетълмент на база обема на инструкциите за сетълмент	Процентна стойност до 2 знака след десетичната запетая.
13.	Процент на неуспешен сетълмент на база стойността (в EUR) на инструкциите за сетълмент	Процентна стойност до 2 знака след десетичната запетая.

Данни, обхващащи случаите на неуспешен сетълмент както поради липса на ценни книжа, така и на парични средства

14.	Общ брой на случаите на неуспешен сетълмент (обхванати са случаите на неуспешен сетълмент както поради липса на ценни книжа, така и на парични средства)	До 20 цифрови знака, отчетени като цяло число без десетични числа.
-----	--	--

№	Данни, които се публикуват	Формат
15.	Общата стойност (в EUR) на случаите на неуспешен сетълмент (обхванати са случаите на неуспешен сетълмент както поради липса на ценни книжа, така и на парични средства)	До 20 цифрови знака, включително десетични числа. Попълва се най-малко един знак преди и един знак след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак.
16.	Процент на случаите на неуспешен сетълмент на база обема на инструкциите за сетълмент	Процентна стойност до 2 знака след десетичната запетая.
17.	Процент на неуспешен сетълмент на база стойност на инструкциите за сетълмент	До 5 цифрови знака, включително десетични числа. Попълва се най-малко един знак преди и един знак след десетичния знак. Десетичният знак не се брои като цифров знак.
18.	Мерки за подобряване на ефикасността на сетълмента	Свободен текст